

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	72
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	72

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	72
§ 8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	73
§ 9 开放式基金份额变动	73
§ 10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	78
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
§ 12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金
基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 06 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	156,798,684.40
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照成份股在沪深 300 安中动态策略指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。沪深 300 安中动态策略指数的提供者将每月更新指数组合的成份股以及相关权重并通知本基金管理人，本基金管理人将做出对应的调整以便匹配目标指数的配置。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	沪深 300 安中动态策略指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种，本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李文	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日 - 2021年06月30日)
本期已实现收益	56,054,578.75
本期利润	21,050,683.01
加权平均基金份额本期利润	0.1126
本期加权平均净值利润率	4.60%
本期基金份额净值增长率	5.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)
期末可供分配利润	204,408,178.43
期末可供分配基金份额利润	1.3036
期末基金资产净值	391,501,572.21
期末基金份额净值	2.4968
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	149.68%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.43%	0.79%	-0.57%	0.79%	1.00%	0.00%
过去三个月	4.46%	0.81%	2.63%	0.81%	1.83%	0.00%
过去六个月	5.12%	1.15%	2.86%	1.16%	2.26%	-0.01%
过去一年	36.62%	1.17%	26.66%	1.19%	9.96%	-0.02%
过去三年	74.67%	1.27%	52.02%	1.29%	22.65%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	149.68%	1.45%	127.10%	1.42%	22.58%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富沪深300安中指数累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 11 月 06 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2021 上半年，汇添富基金新成立 21 只公开募集证券投资基金，包括 7 只股票型基金、13 只混合型基金、1 只债券型基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 189 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限 （年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2013 年 11 月 06 日		15	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7

					日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。 2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放
--	--	--	--	--	---

					式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

					2019 年 11 月 6 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统中的公平交易模块进行操作,实现事前和

事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 14 次，投资组合经理因投资组合的投资策略与其他组合发生同日反向交易，相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批，事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，国内经济持续保持较高的景气度，企业经营状况改善，利润持续增长。大宗商品价格整体上涨，PPI 上行，通胀预期先升后降，整体通胀压力不大。在经济复苏背景下，实体融资需求旺盛，货币政策逐步常态化。

行业角度，新能源汽车、光伏、半导体、生物科技等新兴产业维持高景气，但估值相对较高，价格波动加大；于此同时，原材料价格上涨，叠加“碳中和”背景下的落后产能淘汰预期，周期性行业出现估值修复。

从风格方面来看，上半年市场风格波动较大，春节前侧重核心资产，之后转向价值，二季度成长风格鲜明，核心资产内部出现明显的分化。整体而言，上半年市场风格有以下特点，首先市场风险偏好提升，小市值、高 Beta、低 PB 风格表现较好，而风险规避类的质量因子表现一般；其次，趋势风格整体占优，以动量为代表的价格趋势以及以成长为代表的基本面趋势策略表现好；其三，投资的快逻辑优于慢逻辑，投资者更侧重短期的业绩弹性和财报超预期，对公司质地、竞争壁垒和盈利稳定性的要求有所弱化。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。权益投资仓位报告期内基本保持在 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 5.12%。同期业绩比较基准收益率为 2.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济仍将富有韧性，经济增速整体保持稳健。货币政策方面延续宽货币、紧信用的组合，流动性保持相对稳定。海外随着经济的逐步复苏，政策也将逐步回归常态化，在长期的宽松刺激政策后，美联储货币政策的转向可能带来市场预期的反复波动。

在当前的经济及货币政策组合下，出现单边趋势性行情的概率不大，下半年预计仍然以结构性行情为主。风格角度，下半年可能延续成长风格，但整体将表现得更为均衡。行业方面，上半年的 A 股市场呈现极强的结构性行情特征，行业估值分化程度处于较高的水平。部分行业估值高企，需要充分的业绩增长给予支撑，对短期业绩及外部扰动的敏感性日益提升；同时部分价值型行业已具备较好的左侧配置性价比。在此背景下，对行业进行动态配置的安中动态指数，在这样的市场背景下有望取得较好的投资效果。

汇添富安中动态指数基金是跟踪安中动态指数的基金产品，覆盖面广、结构均衡，是权益资产的基础性配置工具，在投资运作上将严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	18,375,067.88	21,865,836.33
结算备付金		354,304.57	633,634.35
存出保证金		48,446.63	42,992.99
交易性金融资产	6.4.7.2	373,586,751.30	440,622,513.03
其中：股票投资		370,913,021.30	438,034,370.43
基金投资		-	-
债券投资		2,673,730.00	2,588,142.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,179,385.88	15,574,407.48
应收利息	6.4.7.5	51,774.70	54,423.15
应收股利		-	-
应收申购款		451,412.04	131,642.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		394,047,143.00	478,925,449.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,363,203.03	15,924,198.40
应付赎回款		343,788.51	665,856.94
应付管理人报酬		171,709.10	188,723.16
应付托管费		34,341.79	37,744.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	482,100.42	444,356.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	150,427.94	252,136.83
负债合计		2,545,570.79	17,513,016.75
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	156,798,684.40	194,274,433.34
未分配利润	6.4.7.10	234,702,887.81	267,137,999.61
所有者权益合计		391,501,572.21	461,412,432.95
负债和所有者权益总计		394,047,143.00	478,925,449.70

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.4968 元，基金份额总额 156,798,684.40 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		24,221,760.74	40,439,481.86
1. 利息收入		89,295.37	62,209.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	47,415.10	60,036.88
债券利息收入		41,880.27	2,172.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		59,055,981.05	27,801,008.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	56,190,333.03	24,617,633.18
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-1,534.18	-2,250.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,867,182.20	3,185,625.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-35,003,895.74	12,508,625.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	80,380.06	67,637.93
减：二、费用		3,171,077.73	2,104,460.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,137,976.73	825,288.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	227,595.35	165,057.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,606,001.70	914,322.00

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 21	199, 503. 95	199, 791. 90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21, 050, 683. 01	38, 335, 021. 57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21, 050, 683. 01	38, 335, 021. 57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	194, 274, 433. 34	267, 137, 999. 61	461, 412, 432. 95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21, 050, 683. 01	21, 050, 683. 01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-37, 475, 748. 94	-53, 485, 794. 81	-90, 961, 543. 75
其中：1. 基金申购款	25, 764, 237. 07	37, 548, 243. 34	63, 312, 480. 41
2. 基金赎回款	-63, 239, 986. 01	-91, 034, 038. 15	-154, 274, 024. 16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	156, 798, 684. 40	234, 702, 887. 81	391, 501, 572. 21
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	211,022,093.66	131,022,407.25	342,044,500.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,335,021.57	38,335,021.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-26,978,745.84	-17,035,085.36	-44,013,831.20
其中：1. 基金申购款	35,328,379.11	22,875,338.75	58,203,717.86
2. 基金赎回款	-62,307,124.95	-39,910,424.11	-102,217,549.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	184,043,347.82	152,322,343.46	336,365,691.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1209 号文《关于核准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发发行募集，基金合同于 2013 年 11 月 06 日正式生效，首次设立募集规模为 274,994,745.19 基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 安中动态策略指数的成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 安中动态策略指数收益率 $\times 95\%$ + 金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 06 月 30 日
活期存款	18,375,067.88
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	18,375,067.88

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 06 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		343,937,532.12	370,913,021.30	26,975,489.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,694,200.20	2,673,730.00	-20,470.20
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	2,694,200.20	2,673,730.00	-20,470.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		346,631,732.32	373,586,751.30	26,955,018.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	1,619.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	143.55
应收债券利息	49,991.71

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	19.62
合计	51,774.70

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	482,100.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	482,100.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,248.99
应付证券出借违约金	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	50,000.00
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	150,427.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	194,274,433.34	194,274,433.34

本期申购	25,764,237.07	25,764,237.07
本期赎回（以“-”号填列）	-63,239,986.01	-63,239,986.01
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	156,798,684.40	156,798,684.40

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	194,558,324.69	72,579,674.92	267,137,999.61
本期利润	56,054,578.75	-35,003,895.74	21,050,683.01
本期基金份额交易产生的变动数	-46,204,725.01	-7,281,069.80	-53,485,794.81
其中：基金申购款	29,561,790.64	7,986,452.70	37,548,243.34
基金赎回款	-75,766,515.65	-15,267,522.50	-91,034,038.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	204,408,178.43	30,294,709.38	234,702,887.81

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	41,792.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,299.28
其他	323.37
合计	47,415.10

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	557,599,943.57

减：卖出股票成本总额	501,409,610.54
买卖股票差价收入	56,190,333.03

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,404,915.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,375,534.18
减：应收利息总额	30,915.00
买卖债券差价收入	-1,534.18

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,867,182.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,867,182.20

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-35,003,895.74
——股票投资	-34,989,275.82
——债券投资	-14,619.92
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-35,003,895.74

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	80,380.06
替代损益	-
其他	-
合计	80,380.06

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	1,606,001.70
银行间市场交易费用	-
合计	1,606,001.70

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	325.00
指数使用费	100,000.00
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-

合计	199,503.95
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	100,811,379.71	9.87	149,321,770.92	25.86

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	92,440.89	9.80	26,575.66	5.51
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	138,123.80	25.89	10,059.20	4.27

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,137,976.73	825,288.72
其中：支付销售机构的客户维护费	94,079.84	51,296.33

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	227,595.35	165,057.67

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至
-----	--------------------------------	---------------------------

名称	月 30 日		2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	18,375,067.88	41,792.45	15,539,075.17	55,977.92

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300973	立高食品	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	309	8,738.52	35,754.39	
301018	申菱环境	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 07 日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
688499	利元亨	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 01 日	新股流	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	

		日	日	通 受 限						
300957	贝泰妮	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 27 日	新 股 流 通 受 限	47.33	251.96	264	12,495.12	66,517.44	
300982	苏文电能	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新 股 流 通 受 限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
300992	泰福泵业	2021 年 05 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新 股 流 通 受 限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	
301015	百洋医药	2021 年 06 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新 股 流 通 受 限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	
300968	格林精密	2021 年 04 月 06 日	2021 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	
300952	恒辉安防	2021 年 03 月 03 日	2021 年 09 月 13 日	新 股 流 通 受 限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	
301017	漱玉平民	2021 年 06 月 23 日	2022 年 01 月 05 日	新 股 流 通 受	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	

				限						
301017	漱玉平民	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 05 日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	
301016	雷尔伟	2021 年 06 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	
300996	普联软件	2021 年 05 月 26 日	2021 年 12 月 03 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	
301010	晶雪节能	2021 年 06 月 09 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	
300945	曼卡龙	2021 年 02 月 03 日	2021 年 08 月 10 日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	
688685	迈信林	2021 年 04 月 30 日	2021 年 11 月 15 日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	
300614	百川畅银	2021 年 05 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	
688329	艾	2021	2021	新	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84	

	隆科技	年 03 月 16 日	年 09 月 29 日	股 流 通 受 限						
300995	奇德新材	2021 年 05 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新 股 流 通 受 限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	
688665	四方光电	2021 年 02 月 02 日	2021 年 08 月 09 日	新 股 流 通 受 限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	
301018	申菱环境	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 07 日	新 股 流 通 受 限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	
688607	康众医疗	2021 年 01 月 25 日	2021 年 08 月 02 日	新 股 流 通 受 限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	
300955	嘉亨家化	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 24 日	新 股 流 通 受 限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	
605162	新中港	2021 年 06 月 29 日	2021 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	
300967	晓鸣股	2021 年 04 月 02 日	2021 年 10 月 13 日	新 股 流	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	

	份	日	日	通 受 限						
301007	德 迈 仕	2021 年 06 月 04 日	2021 年 12 月 16 日	新 股 流 通 受 限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
300991	创 益 通	2021 年 05 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新 股 流 通 受 限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	
300971	博 亚 精 工	2021 年 04 月 07 日	2021 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	
301021	英 诺 激 光	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 06 日	新 股 流 通 受 限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
301021	英 诺 激 光	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新 股 流 通 受 限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	
300958	建 工 修 复	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 29 日	新 股 流 通 受 限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	
300981	中 红 医 疗	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新 股 流 通 受	48.59	90.39	241	11,710.19	21,783.99	

				限						
300942	易瑞生物	2021 年 02 月 02 日	2021 年 08 月 09 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	
301011	华立科技	2021 年 06 月 09 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	
300930	屹通新材	2021 年 01 月 13 日	2021 年 07 月 21 日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	
300950	德固特	2021 年 02 月 24 日	2021 年 09 月 03 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	
300966	共同药业	2021 年 03 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	
605287	德才股份	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	
688087	英科再生	2021 年 06 月 30 日	2021 年 07 月 09 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,345	51,496.20	51,496.20	
301012	扬	2021	2021	新	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	

	电 科 技	年 06 月 15 日	年 12 月 22 日	股 流 通 受 限						
688575	亚 辉 龙	2021 年 05 月 10 日	2021 年 11 月 17 日	新 股 流 通 受 限	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	
300948	冠 中 生 态	2021 年 02 月 18 日	2021 年 08 月 25 日	新 股 流 通 受 限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	
688226	威 腾 电 气	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
300933	中 辰 股 份	2021 年 01 月 15 日	2021 年 07 月 22 日	新 股 流 通 受 限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	
300997	欢 乐 家	2021 年 05 月 26 日	2021 年 12 月 02 日	新 股 流 通 受 限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	
300993	玉 马 遮 阳	2021 年 05 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新 股 流 通 受 限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	
688456	有 研 粉	2021 年 03 月 10	2021 年 09 月 17	新 股 流	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	

	材	日	日	通 受 限						
300962	中金 辐照	2021 年 03 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新 股 流 通 受 限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	
300972	万辰 生物	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 19 日	新 股 流 通 受 限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	
300929	华骐 环保	2021 年 01 月 12 日	2021 年 07 月 21 日	新 股 流 通 受 限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	
300943	春晖 智控	2021 年 02 月 03 日	2021 年 08 月 10 日	新 股 流 通 受 限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	
300986	志特 新材	2021 年 04 月 21 日	2021 年 11 月 01 日	新 股 流 通 受 限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	可 流 通 日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“冠中生态”（证券代码：300948）包含其新股发行后期根

据权益分配方案以资本公积金转增获得的 108 股（根据冠中生态 2020 年年度权益分派实施公告，冠中生态以公司现有总股本 93,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 0.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2021 年 6 月 4 日。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021 年 06 月 16 日	重大资产重组	5.59	2021 年 07 月 06 日	6.15	51,459	492,944.65	287,655.81	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外,本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 1 年 06 月 30 日	1 个月以内	1- 3 个 月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	18,375,067.88	-	-	-	-	-	18,375,067.88
结 算 备 付 金	354,304.57	-	-	-	-	-	354,304.57
存 出 保 证 金	48,446.63	-	-	-	-	-	48,446.63
交 易 性 金 融 资 产	2,372,800.00	-	300,930.00	-	-	370,913,021.30	373,586,751.30

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	51,774.70	51,774.70
应收申购款	-	-	-	-	-	451,412.04	451,412.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,179,385.88	1,179,385.88
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,150,619.08	-	300,930.00	-	-	372,595,593.92	394,047,143.00
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	343,788.51	343,788.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	171,709.10	171,709.10
应付托管费	-	-	-	-	-	34,341.79	34,341.79
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,363,203.03	1,363,203.03
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易	-	-	-	-	-	482,100.42	482,100.42

费用							
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	150,427.94	150,427.94
负债总计	-	-	-	-	-	2,545,570.79	2,545,570.79
利率敏感度缺口	21,150,619.08	-	300,930.00	-	-	370,050,023.13	391,501,572.21
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存	21,865,836.33	-	-	-	-	-	21,865,836.33

款							
结算 备付金	633,634.35	-	-	-	-	-	633,634.35
存出 保证金	42,992.99	-	-	-	-	-	42,992.99
交易性 金融资产	1,373,862.60	-	1,214,280.00	-	-	438,034,370.43	440,622,513.03
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 利息	-	-	-	-	-	54,423.15	54,423.15
应收 申购款	-	-	-	-	-	131,642.37	131,642.37
衍生 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 证券 清算款	-	-	-	-	-	15,574,407.48	15,574,407.48

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,916,326.27	-	1,214,280.00	-	-	453,794,843.43	478,925,449.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	665,856.94	665,856.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	188,723.16	188,723.16
应付托管费	-	-	-	-	-	37,744.63	37,744.63
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15,924,198.40	15,924,198.40
卖出	-	-	-	-	-	-	-

回 购 金 融 资 产 款							
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	-	-
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	444,356.79	444,356.79
应 交 税 费	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 息	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	252,136.83	252,136.83
负 债 总 计	-	-	-	-	-	17,513,016.75	17,513,016.75
利 率 敏 感	23,916,326.27	-	1,214,280.00	-	-	436,281,826.68	461,412,432.95

度 缺 口							
-------------	--	--	--	--	--	--	--

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	713.66	1,818.85
	基准利率增加 25 个基点	-712.93	-1,812.19

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	370,913,021.30	94.74	438,034,370.43	94.93
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,673,730.00	0.68	2,588,142.60	0.56
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	373,586,751.30	95.42	440,622,513.03	95.49

注：本基金投资于沪深 300 安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 安中动态策略指数下跌 5%	-18,281,347.34	-21,549,751.73
	沪深 300 安中动态策略指数上涨 5%	18,281,347.34	21,549,751.73

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	370,913,021.30	94.13
	其中：股票	370,913,021.30	94.13
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,673,730.00	0.68
	其中：债券	2,673,730.00	0.68
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	18,729,372.45	4.75
8	其他资产	1,731,019.25	0.44
9	合计	394,047,143.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,630,101.10	0.42
B	采矿业	57,200,569.25	14.61
C	制造业	190,288,949.63	48.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,515,664.39	6.52
E	建筑业	4,840,634.27	1.24
F	批发和零售业	1,353,999.60	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	11,194,688.65	2.86
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,215,823.33	5.67
J	金融业	22,683,909.37	5.79
K	房地产业	1,808,665.43	0.46
L	租赁和商务服务业	4,922,888.32	1.26
M	科学研究和技术服务业	3,296,376.31	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	509,716.00	0.13
Q	卫生和社会工作	4,417,457.54	1.13

R	文化、体育和娱乐业	1,159,871.00	0.30
S	综合	—	—
	合计	353,039,314.19	90.18

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	65,495.00	0.02
B	采矿业	76,751.35	0.02
C	制造业	14,266,241.72	3.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,347.29	0.01
E	建筑业	195,927.08	0.05
F	批发和零售业	568,509.90	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,637,757.99	0.42
J	金融业	146,519.40	0.04
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.02
M	科学研究和技术服务业	131,868.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	243,534.67	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	399,425.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	17,873,707.11	4.57

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	765,937	15,808,939.68	4.04
2	601088	中国神	764,611	14,925,206.72	3.81

		华			
3	600028	中国石化	3,111,733	13,567,155.88	3.47
4	000063	中兴通讯	400,228	13,299,576.44	3.40
5	601857	中国石油	2,278,670	12,054,164.30	3.08
6	601225	陕西煤业	924,066	10,950,182.10	2.80
7	600050	中国联通	2,398,868	10,363,109.76	2.65
8	600519	贵州茅台	4,832	9,937,974.40	2.54
9	600745	闻泰科技	83,800	8,120,220.00	2.07
10	601012	隆基股份	77,127	6,851,962.68	1.75
11	002415	海康威视	90,849	5,859,760.50	1.50
12	688036	传音控股	27,353	5,730,453.50	1.46
13	601138	工业富联	390,600	4,847,346.00	1.24
14	000333	美的集团	64,410	4,596,941.70	1.17
15	000858	五粮液	14,669	4,369,748.41	1.12
16	000725	京东方 A	697,138	4,350,141.12	1.11
17	002475	立讯精密	93,225	4,288,350.00	1.10
18	300136	信维通信	126,200	3,897,056.00	1.00
19	601888	中国中免	12,224	3,668,422.40	0.94
20	600276	恒瑞医药	51,196	3,479,792.12	0.89
21	603501	韦尔股份	10,200	3,284,400.00	0.84
22	601318	中国平安	50,888	3,271,080.64	0.84
23	600031	三一重工	110,685	3,217,612.95	0.82

24	600522	中天科技	317,600	3,176,000.00	0.81
25	000651	格力电器	60,915	3,173,671.50	0.81
26	600036	招商银行	58,089	3,147,842.91	0.80
27	603259	药明康德	19,309	3,023,596.31	0.77
28	300628	亿联网络	34,700	2,907,860.00	0.74
29	002594	比亚迪	11,347	2,848,097.00	0.73
30	600309	万华化学	25,956	2,824,531.92	0.72
31	601919	中远海控	84,514	2,581,057.56	0.66
32	002230	科大讯飞	36,932	2,495,864.56	0.64
33	002352	顺丰控股	34,500	2,335,650.00	0.60
34	601899	紫金矿业	230,675	2,235,240.75	0.57
35	300014	亿纬锂能	21,300	2,213,709.00	0.57
36	003816	中国广核	826,600	2,207,022.00	0.56
37	000100	TCL 科技	283,765	2,170,802.25	0.55
38	300124	汇川技术	28,903	2,146,336.78	0.55
39	002241	歌尔股份	47,582	2,033,654.68	0.52
40	300015	爱尔眼科	28,179	2,000,145.42	0.51
41	601816	京沪高铁	377,700	1,998,033.00	0.51
42	002812	恩捷股份	8,502	1,990,318.20	0.51
43	601808	中海油服	138,201	1,984,566.36	0.51
44	600438	通威股份	44,901	1,942,866.27	0.50
45	600795	国电电力	799,148	1,941,929.64	0.50
46	603986	兆易创	10,252	1,926,350.80	0.49

		新			
47	601985	中国核电	364,700	1,845,382.00	0.47
48	601668	中国建筑	393,174	1,828,259.10	0.47
49	600703	三安光电	56,126	1,798,838.30	0.46
50	600886	国投电力	184,887	1,776,764.07	0.45
51	600887	伊利股份	48,232	1,776,384.56	0.45
52	002460	赣锋锂业	13,800	1,671,042.00	0.43
53	002271	东方雨虹	30,150	1,667,898.00	0.43
54	600585	海螺水泥	40,625	1,667,656.25	0.43
55	600570	恒生电子	16,881	1,574,153.25	0.40
56	000338	潍柴动力	87,960	1,571,845.20	0.40
57	300122	智飞生物	8,400	1,568,532.00	0.40
58	002129	中环股份	40,000	1,544,000.00	0.39
59	603799	华友钴业	13,324	1,521,600.80	0.39
60	600436	片仔癀	3,250	1,456,975.00	0.37
61	601766	中国中车	234,256	1,424,276.48	0.36
62	601166	兴业银行	69,163	1,421,299.65	0.36
63	002410	广联达	19,800	1,350,360.00	0.34
64	000568	泸州老窖	5,658	1,334,948.52	0.34
65	002371	北方华创	4,700	1,303,686.00	0.33
66	002049	紫光国微	8,400	1,295,196.00	0.33
67	603288	海天味业	9,912	1,278,152.40	0.33
68	600690	海尔智家	48,528	1,257,360.48	0.32

69	002027	分众传媒	133,312	1,254,465.92	0.32
70	600011	华能国际	292,800	1,235,616.00	0.32
71	600406	国电南瑞	52,624	1,222,981.76	0.31
72	600809	山西汾酒	2,700	1,209,600.00	0.31
73	000661	长春高新	3,100	1,199,700.00	0.31
74	300059	东方财富	36,133	1,184,801.07	0.30
75	600588	用友网络	34,693	1,153,889.18	0.29
76	002714	牧原股份	18,835	1,145,544.70	0.29
77	600019	宝钢股份	148,474	1,134,341.36	0.29
78	601988	中国银行	367,534	1,132,004.72	0.29
79	300347	泰格医药	5,800	1,121,140.00	0.29
80	600893	航发动力	20,707	1,101,405.33	0.28
81	600660	福耀玻璃	18,646	1,041,379.10	0.27
82	600763	通策医疗	2,500	1,027,500.00	0.26
83	000001	平安银行	45,361	1,026,065.82	0.26
84	601390	中国中铁	193,770	1,015,354.80	0.26
85	300142	沃森生物	16,301	1,005,771.70	0.26
86	600104	上汽集团	44,382	975,072.54	0.25
87	600030	中信证券	39,004	972,759.76	0.25
88	600584	长电科技	25,000	942,000.00	0.24
89	601698	中国卫通	57,300	927,687.00	0.24
90	300408	三环集团	21,600	916,272.00	0.23

91	002304	洋河股份	4,378	907,121.60	0.23
92	600196	复星医药	12,393	893,907.09	0.23
93	300433	蓝思科技	30,199	888,152.59	0.23
94	002179	中航光电	10,943	864,715.86	0.22
95	688012	中微公司	5,200	862,784.00	0.22
96	600346	恒力石化	32,860	862,246.40	0.22
97	600009	上海机场	17,866	859,890.58	0.22
98	002493	荣盛石化	47,500	820,325.00	0.21
99	002236	大华股份	38,007	801,947.70	0.20
100	002841	视源股份	6,400	795,456.00	0.20
101	600111	北方稀土	37,408	774,345.60	0.20
102	000002	万科 A	32,023	762,467.63	0.19
103	000625	长安汽车	28,938	760,490.64	0.19
104	002050	三花智控	31,127	746,425.46	0.19
105	000157	中联重科	80,615	744,882.60	0.19
106	601006	大秦铁路	113,093	744,151.94	0.19
107	002601	龙鳞佰利	21,500	743,470.00	0.19
108	601100	恒立液压	8,428	724,133.76	0.18
109	601989	中国重工	174,300	718,116.00	0.18
110	600025	华能水电	120,900	700,011.00	0.18
111	000786	北新建材	17,500	686,875.00	0.18
112	000768	中航西飞	26,032	684,120.96	0.17

113	601633	长城汽车	15,639	681,704.01	0.17
114	002555	三七互娱	28,300	679,766.00	0.17
115	601186	中国铁建	88,266	655,816.38	0.17
116	300601	康泰生物	4,400	655,600.00	0.17
117	002008	大族激光	16,071	649,107.69	0.17
118	000938	紫光股份	29,390	643,053.20	0.16
119	002202	金风科技	52,184	634,557.44	0.16
120	002821	凯莱英	1,700	633,420.00	0.16
121	002142	宁波银行	16,223	632,210.31	0.16
122	000538	云南白药	5,435	628,938.20	0.16
123	300413	芒果超媒	9,160	628,376.00	0.16
124	601328	交通银行	127,193	623,245.70	0.16
125	600760	中航沈飞	10,220	616,266.00	0.16
126	600176	中国巨石	39,650	614,971.50	0.16
127	603993	洛阳钼业	118,276	610,304.16	0.16
128	000977	浪潮信息	21,200	596,356.00	0.15
129	600352	浙江龙盛	43,385	596,109.90	0.15
130	600010	宝钢股份	380,788	590,221.40	0.15
131	600547	山东黄金	30,466	585,556.52	0.15
132	603019	中科曙光	21,200	585,332.00	0.15
133	600150	中国船舶	35,100	579,501.00	0.15
134	000425	徐工机械	89,083	567,458.71	0.14

135	601600	中国铝业	107,038	567,301.40	0.14
136	601669	中国电建	145,143	561,703.41	0.14
137	603899	晨光文具	6,600	558,096.00	0.14
138	688008	澜起科技	8,900	555,182.00	0.14
139	601877	正泰电器	16,500	550,770.00	0.14
140	600000	浦发银行	54,445	544,450.00	0.14
141	603160	汇顶科技	4,100	531,483.00	0.14
142	601360	三六零	43,400	529,914.00	0.14
143	002384	东山精密	25,100	523,084.00	0.13
144	002311	海大集团	6,398	522,076.80	0.13
145	600741	华域汽车	19,501	512,291.27	0.13
146	002607	中公教育	24,400	509,716.00	0.13
147	002624	完美世界	21,300	509,283.00	0.13
148	000066	中国长城	34,100	497,860.00	0.13
149	002001	新和成	16,920	485,265.60	0.12
150	600183	生益科技	20,700	484,587.00	0.12
151	300498	温氏股份	33,720	484,556.40	0.12
152	002600	领益智造	51,600	474,204.00	0.12
153	600989	宝丰能源	34,500	471,960.00	0.12
154	600029	南方航空	77,731	467,940.62	0.12
155	601601	中国太保	15,855	459,319.35	0.12
156	002938	鹏鼎控股	12,727	456,644.76	0.12

157	002414	高德红 外	16,540	456,173.20	0.12
158	002602	世纪华 通	69,980	449,271.60	0.11
159	300003	乐普医 疗	13,800	443,256.00	0.11
160	000703	恒逸石 化	36,691	438,457.45	0.11
161	002007	华兰生 物	11,923	437,335.64	0.11
162	600016	民生银 行	98,776	435,602.16	0.11
163	000963	华东医 药	9,383	431,711.83	0.11
164	601727	上海电 气	97,791	414,633.84	0.11
165	601111	中国国 航	53,065	412,845.70	0.11
166	601800	中国交 建	63,075	408,726.00	0.10
167	600048	保利地 产	33,693	405,663.72	0.10
168	600115	中国东 航	79,811	405,439.88	0.10
169	601288	农业银 行	133,593	404,786.79	0.10
170	600845	宝信软 件	7,880	401,092.00	0.10
171	600362	江西铜 业	17,601	393,910.38	0.10
172	600837	海通证 券	34,195	393,242.50	0.10
173	600919	江苏银 行	54,920	389,932.00	0.10
174	601688	华泰证 券	24,158	381,696.40	0.10
175	601229	上海银 行	46,137	378,323.40	0.10
176	601618	中国中 冶	124,421	370,774.58	0.09
177	601021	春秋航 空	6,410	364,729.00	0.09
178	000708	中信特 钢	17,500	364,700.00	0.09

179	300529	健帆生物	4,200	362,712.00	0.09
180	002456	欧菲光	40,487	359,524.56	0.09
181	002558	巨人网络	26,801	356,453.30	0.09
182	603833	欧派家居	2,500	354,900.00	0.09
183	601211	国泰君安	20,400	349,656.00	0.09
184	300144	宋城演艺	20,640	346,752.00	0.09
185	002916	深南电路	3,080	342,280.40	0.09
186	000895	双汇发展	10,742	341,595.60	0.09
187	002463	沪电股份	22,000	340,340.00	0.09
188	601169	北京银行	68,650	334,325.50	0.09
189	600999	招商证券	16,963	322,636.26	0.08
190	600600	青岛啤酒	2,700	312,255.00	0.08
191	601238	广汽集团	23,900	309,505.00	0.08
192	600118	中国卫星	10,440	305,474.40	0.08
193	601216	君正集团	57,934	294,884.06	0.08
194	601818	光大银行	76,410	288,829.80	0.07
195	002508	老板电器	6,200	288,300.00	0.07
196	600489	中金黄金	33,433	288,192.46	0.07
197	002024	苏宁易购	51,459	287,655.81	0.07
198	600018	上港集团	59,630	284,435.10	0.07
199	600085	同仁堂	6,844	279,577.40	0.07
200	002252	上海莱士	37,070	277,654.30	0.07
201	300676	华大基	2,300	272,780.00	0.07

		因			
202	002120	韵达股份	20,099	271,939.47	0.07
203	603369	今世缘	5,000	270,800.00	0.07
204	002044	美年健康	29,492	268,672.12	0.07
205	601607	上海医药	12,560	265,392.80	0.07
206	601628	中国人寿	7,711	261,325.79	0.07
207	688009	中国通号	45,635	259,663.15	0.07
208	601872	招商轮船	54,840	253,360.80	0.06
209	000876	新希望	17,136	251,385.12	0.06
210	600161	天坛生物	7,200	246,600.00	0.06
211	601009	南京银行	23,036	242,338.72	0.06
212	600332	白云山	7,151	242,061.35	0.06
213	600655	豫园股份	19,700	228,323.00	0.06
214	601377	兴业证券	23,626	228,227.16	0.06
215	601658	邮储银行	44,200	221,884.00	0.06
216	000596	古井贡酒	900	215,550.00	0.06
217	600233	圆通速递	21,500	215,215.00	0.05
218	601231	环旭电子	12,400	208,444.00	0.05
219	601939	建设银行	30,874	205,312.10	0.05
220	002153	石基信息	8,592	201,997.92	0.05
221	600926	杭州银行	13,600	200,600.00	0.05
222	600482	中国动力	11,400	198,588.00	0.05
223	601336	新华保险	4,224	193,923.84	0.05

224	000166	申万宏源	41,230	192,956.40	0.05
225	603392	万泰生物	740	191,793.20	0.05
226	002739	万达电影	11,700	184,743.00	0.05
227	603195	公牛集团	900	181,800.00	0.05
228	600872	中炬高新	4,300	180,686.00	0.05
229	601901	方正证券	18,800	175,968.00	0.04
230	600015	华夏银行	28,410	175,857.90	0.04
231	000860	顺鑫农业	4,100	172,938.00	0.04
232	601788	光大证券	9,008	161,153.12	0.04
233	603658	安图生物	2,060	156,086.20	0.04
234	001979	招商蛇口	14,148	154,920.60	0.04
235	002032	苏泊尔	2,300	146,717.00	0.04
236	002736	国信证券	13,200	141,900.00	0.04
237	601066	中信建投	4,500	141,435.00	0.04
238	601933	永辉超市	29,792	140,916.16	0.04
239	600109	国金证券	10,902	138,346.38	0.04
240	601916	浙商银行	34,300	136,171.00	0.03
241	000069	华侨城 A	18,287	136,055.28	0.03
242	002157	正邦科技	11,300	135,035.00	0.03
243	601838	成都银行	10,400	131,456.00	0.03
244	000783	长江证券	17,542	128,407.44	0.03
245	601108	财通证券	11,200	117,488.00	0.03

246	601555	东吴证券	13,881	115,767.54	0.03
247	300033	同花顺	1,000	112,780.00	0.03
248	000728	国元证券	13,584	108,264.48	0.03
249	600383	金地集团	10,330	105,779.20	0.03
250	601077	渝农商行	26,200	104,538.00	0.03
251	600061	国投资本	11,320	96,106.80	0.02
252	601878	浙商证券	7,100	92,868.00	0.02
253	601162	天风证券	19,050	92,583.00	0.02
254	002773	康弘药业	4,000	92,520.00	0.02
255	600705	中航资本	23,338	90,318.06	0.02
256	600606	绿地控股	15,900	86,655.00	0.02
257	601990	南京证券	8,000	84,160.00	0.02
258	000656	金科股份	14,400	83,376.00	0.02
259	603087	甘李药业	700	74,606.00	0.02
260	002673	西部证券	8,980	74,085.00	0.02
261	600848	上海临港	4,120	73,748.00	0.02
262	601881	中国银河	6,600	71,148.00	0.02
263	601998	中信银行	13,509	68,895.90	0.02
264	601319	中国人保	10,500	62,265.00	0.02
265	601696	中银证券	2,800	57,652.00	0.01
266	600299	安迪苏	4,500	53,820.00	0.01
267	002939	长城证券	4,800	53,424.00	0.01
268	601236	红塔证	3,800	51,528.00	0.01

		券			
269	600918	中泰证 券	4,400	47,608.00	0.01
270	002945	华林证 券	800	11,056.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	300274	阳光电源	18,000	2,071,080.00	0.53
2	688111	金山办公	3,500	1,381,800.00	0.35
3	300450	先导智能	19,500	1,172,730.00	0.30
4	600426	华鲁恒升	24,500	758,275.00	0.19
5	603806	福斯特	7,000	735,910.00	0.19
6	600143	金发科技	29,000	604,940.00	0.15
7	300595	欧普康视	5,500	569,525.00	0.15
8	688396	华润微	5,500	500,610.00	0.13
9	603659	璞泰来	3,500	478,100.00	0.12
10	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.10
11	603882	金域医学	2,500	399,425.00	0.10
12	601799	星宇股份	1,500	338,580.00	0.09
13	688126	沪硅产业	10,500	306,390.00	0.08
14	600132	重庆啤酒	1,500	296,925.00	0.08
15	600079	人福医药	10,500	296,835.00	0.08
16	688161	威高骨科	2,675	283,683.75	0.07
17	688269	凯立新	1,941	270,808.32	0.07

		材			
18	300558	贝达药业	2,500	270,600.00	0.07
19	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.06
20	300677	英科医疗	2,000	249,600.00	0.06
21	603338	浙江鼎力	4,000	234,760.00	0.06
22	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.06
23	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.06
24	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.05
25	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.04
26	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.04
27	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.04
28	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.04
29	603939	益丰药房	2,800	157,052.00	0.04
30	300903	科翔股份	4,775	153,086.50	0.04
31	600521	华海药业	7,200	150,336.00	0.04
32	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.04
33	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.04
34	603517	绝味食品	1,600	134,864.00	0.03
35	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.03
36	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.03
37	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.03
38	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.03
39	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
40	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.03
41	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.03

42	000800	一汽解放	9,600	103,872.00	0.03
43	603233	大参林	2,000	102,220.00	0.03
44	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.02
45	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.02
46	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.02
47	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.02
48	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.02
49	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
50	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.02
51	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.02
52	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.02
53	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.02
54	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.02
55	300957	贝泰妮	264	66,517.44	0.02
56	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
57	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.02
58	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.02
59	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.02
60	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.02
61	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.01
62	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
63	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.01
64	688087	英科再生	2,345	51,496.20	0.01
65	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
66	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01

67	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.01
68	601995	中金公司	800	49,200.00	0.01
69	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
70	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.01
71	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
72	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
73	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.01
74	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
75	300973	立高食品	309	35,754.39	0.01
76	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.01
77	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
78	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
79	605089	味知香	370	32,197.40	0.01
80	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
81	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.01
82	605296	神农集团	569	26,856.80	0.01
83	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
84	300981	中红医疗	241	21,783.99	0.01
85	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.01
86	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
87	300884	狄耐克	749	20,133.12	0.01
88	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
89	001205	盛航股	577	18,850.59	0.00

		份			
90	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
91	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
92	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
93	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
94	300909	汇创达	362	15,602.20	0.00
95	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
96	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
97	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
98	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
99	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
100	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
101	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
102	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
103	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
104	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
105	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
106	300986	志特新材	332	10,808.84	0.00
107	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
108	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
109	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
110	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
111	300952	恒辉安	340	9,207.20	0.00

		防			
112	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
113	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
114	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
115	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
116	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
117	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
118	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
119	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
120	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
121	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
122	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
123	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
124	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
125	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
126	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	20,812,427.00	4.51
2	000063	中兴通讯	15,323,342.13	3.32
3	600050	中国联通	11,717,142.60	2.54
4	601088	中国神华	10,834,454.00	2.35
5	000858	五粮液	10,680,583.00	2.31
6	600028	中国石化	9,625,547.00	2.09

7	600745	闻泰科技	9,589,738.00	2.08
8	002415	海康威视	9,340,677.77	2.02
9	600900	长江电力	9,153,735.04	1.98
10	002475	立讯精密	8,002,079.47	1.73
11	000725	京东方 A	7,705,391.00	1.67
12	600309	万华化学	7,243,865.20	1.57
13	601225	陕西煤业	7,086,684.90	1.54
14	601857	中国石油	6,988,485.00	1.51
15	601899	紫金矿业	6,409,195.00	1.39
16	688036	传音控股	6,405,664.26	1.39
17	601138	工业富联	6,195,177.00	1.34
18	003816	中国广核	5,983,738.00	1.30
19	600276	恒瑞医药	5,920,621.00	1.28
20	601318	中国平安	5,379,641.00	1.17

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	31,286,139.74	6.78
2	000858	五粮液	17,502,952.94	3.79
3	600276	恒瑞医药	13,835,669.47	3.00
4	600900	长江电力	10,620,517.00	2.30
5	000063	中兴通讯	9,364,964.00	2.03
6	600309	万华化学	8,400,983.70	1.82
7	000333	美的集团	8,322,813.81	1.80
8	603259	药明康德	8,009,198.68	1.74
9	600887	伊利股份	7,864,787.54	1.70
10	601899	紫金矿业	7,137,035.00	1.55
11	002415	海康威视	6,779,627.00	1.47
12	003816	中国广核	6,546,683.16	1.42
13	601985	中国核电	6,280,454.00	1.36
14	600886	国投电力	6,256,652.00	1.36
15	002475	立讯精密	6,056,507.38	1.31
16	600795	国电电力	5,999,576.00	1.30
17	002714	牧原股份	5,738,383.58	1.24
18	600585	海螺水泥	5,737,968.74	1.24
19	601088	中国神华	5,735,361.00	1.24
20	601888	中国中免	5,565,418.71	1.21

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	469,277,537.23
卖出股票收入（成交）总额	557,599,943.57

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,673,730.00	0.68
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,673,730.00	0.68

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债 (7)	14,000	1,402,800.00	0.36
2	019640	20 国债 10	9,700	970,000.00	0.25
3	019645	20 国债 15	3,000	300,930.00	0.08

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,山东华鲁恒升化工股份有限公司、中国石油天然气股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	48,446.63
2	应收证券清算款	1,179,385.88
3	应收股利	-
4	应收利息	51,774.70
5	应收申购款	451,412.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,731,019.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
7,494	20,923.23	99,731,530.70	63.60	57,067,153.70	36.40

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,894.28	0.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 11 月 06 日）基金份额总额	274,994,745.19
本报告期期初基金份额总额	194,274,433.34
本报告期基金总申购份额	25,764,237.07
减：本报告期基金总赎回份额	63,239,986.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	156,798,684.40

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信	2	214,646,664.04	21.01	195,609.22	20.74	

证券						
中金公司	2	188,989,912.43	18.50	176,005.76	18.66	
东吴证券	1	126,478,260.57	12.38	117,789.05	12.49	
长江证券	1	118,873,409.07	11.64	110,706.37	11.74	
东方证券	3	100,811,379.71	9.87	92,440.89	9.80	
国信证券	2	96,240,767.23	9.42	89,607.66	9.50	
东兴证券	1	75,502,098.31	7.39	68,805.32	7.29	
中信建投证券	1	40,592,749.10	3.97	37,803.65	4.01	
信达证券	1	19,765,069.99	1.93	18,011.91	1.91	
中泰证券	1	19,131,217.58	1.87	17,434.15	1.85	
中银国际	1	18,608,268.91	1.82	17,329.02	1.84	
瑞银证券	2	1,059,419.22	0.10	986.64	0.10	
国海证券	2	459,486.99	0.04	427.92	0.05	
国泰君安	1	199,460.75	0.02	181.77	0.02	
兴业证券	1	165,265.50	0.02	153.91	0.02	
申万宏源证券	1	89,314.58	0.01	83.17	0.01	
长城证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华泰	2	-	-	-	-	

证券						
华西 证券	1	-	-	-	-	
平安 证券	1	-	-	-	-	
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	
银河 证券	1	-	-	-	-	

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例 (%)	成交 金额	占当期 权证成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	202,292.50	13.71	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	971,649.00	65.84	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	301,800.00	20.45	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商

评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理人托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 01 月 09 日
2	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	公司网站	2021 年 02 月 08 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 03 月 30 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要	上交所,公司网站,深交所	2021 年 04 月 02 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 04 月 22 日

8	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日
---	---------------------------	---------------------	------------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	128,363,811.99	-	33,336,000.00	95,027,811.99	60.60

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时,少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高,其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时,更容易触发巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致基金规模较小,基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元,进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 08 月 31 日